

ENQUADRAMENTO LEGAL



SBCPREV

31/03/2017

Fundo	Valor Investido R\$	% Recursos	Limite PI	PL Fundo	% PL Fundo	Adequação Fundo	Diversificação		Rentabilidades				
							RPPS	Fundo	1 mês	3 meses	6 meses	12 meses	No Ano
RF	696.400.750,24		159,00%						1,24%	5,39%	8,85%	17,59%	5,39%
RV	131.800.296,44		41,00%						-2,01%	7,60%	8,87%	23,81%	7,60%
CONSOLIDADO	828.152.635,17		200,00%						0,73%	5,87%	9,23%	19,06%	5,87%
META ATUARIAL (INPC + 6%)									0,81%	2,46%	4,36%	10,84%	2,46%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)									0,74%	2,44%	4,72%	10,85%	2,44%
Títulos Públicos	166.761.782,79	20,14%	40,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
CARTEIRA PROPRIA SBCPREV	166.761.782,79	20,14%		-	-	-	-	-	1,08%	6,31%	9,07%	17,44%	6,31%
Fundos que contenham somente títulos públicos	280.788.790,70	33,91%	50,00%			Art. 7o, Inciso I, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M FI	23.423.196,92	2,83%		4.952.567.108,47	0,47%	OK	OK	OK	1,47%	5,89%	9,44%	20,94%	5,89%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	98.727.721,71	11,92%		2.763.416.568,18	3,57%	OK	OK	OK	1,43%	5,88%	9,49%	21,04%	5,88%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	81.778.947,94	9,87%		5.761.023.230,35	1,42%	OK	OK	OK	1,38%	4,05%	6,36%	13,89%	4,05%
GF FC FI RF IMA B	13.017.445,57	1,57%		81.102.227,99	16,05%	OK	OK	OK	1,10%	6,96%	9,51%	21,53%	6,96%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5 FICFI	6.292.402,59	0,76%		1.967.281.822,23	0,32%	OK	OK	OK	1,35%	3,99%	6,25%	13,66%	3,99%
SAFRA IMA FIC FI RF	9.122.271,78	1,10%		429.907.422,11	2,12%	OK	OK	OK	1,23%	6,80%	9,04%	20,35%	6,80%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	48.426.804,19	5,85%		1.053.698.055,10	4,60%	OK	OK	OK	1,38%	4,06%	6,37%	13,91%	4,06%
Fundos Renda Fixa / Referenciados Renda Fixa IMA e IDkA	176.389.159,78	21,30%	35,00%			Art. 7o, Inciso III, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B 5 LP FC	40.119.415,75	4,84%		1.981.038.461,24	2,03%	OK	OK	OK	1,38%	4,05%	6,34%	13,92%	4,05%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B FI	47.986.618,48	5,79%		1.303.474.709,01	3,68%	OK	OK	OK	1,05%	6,96%	9,42%	21,57%	6,96%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B	43.728.847,98	5,28%		1.671.596.593,45	2,62%	OK	OK	OK	1,06%	7,08%	9,67%	22,16%	7,08%
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5	24.868.811,99	3,00%		267.792.387,25	9,29%	OK	OK	OK	1,45%	4,29%	6,64%	14,22%	4,29%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	19.685.465,58	2,38%		2.562.643.492,65	0,77%	OK	OK	OK	0,95%	6,74%	9,38%	21,28%	6,74%
Fundos de Renda Fixa (Normal)	65.841.687,72	7,95%	30,00%			Art. 7o, Inciso IV, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
AZ QUEST YIELD FC FI RF LONGO PRAZO	12.450.935,68	1,50%		180.464.725,01	6,90%	OK	OK	OK	1,52%	4,94%	7,12%	15,06%	4,94%
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	12.746.330,87	1,54%		7.549.648.257,31	0,17%	OK	OK	OK	1,05%	3,05%	6,61%	14,06%	3,05%
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	32.183.699,08	3,89%		1.379.440.423,38	2,33%	OK	OK	OK	1,32%	6,11%	9,19%	20,42%	6,11%
SANTANDER FC MASTER RF REF DI	8.460.722,09	1,02%		8.687.047.126,70	0,10%	OK	OK	OK	1,00%	2,86%	6,02%	12,98%	2,86%
FIDC	6.388.764,32	0,77%	2,00%			Art. 7o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
OURINVEST FIDC FINAN SUPPLIER SENIOR 1	6.388.764,32	0,77%		375.476.402,91	1,70%	OK	OK	OK	1,21%	3,50%	7,37%	15,98%	3,50%
FIDC Fechado	140.618,38	0,02%	1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea A					Alocação:	Enquadrado	
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR	32.531,58	0,00%		759.071,57	4,29%	OK	OK	OK	-9,73%	-92,90%	-22,39%	531,87%	-92,90%
FIDC TREND BANK MULTISSETORIAL 2 SEN	108.086,80	0,01%		2.172.577,65	4,98%	OK	OK	OK	-2,93%	-7,35%	-15,10%	-19,24%	-7,35%
Fundo Crédito Privado			1,00%			Art. 7o, Inciso VII, Alínea B					Alocação:	Enquadrado	
Fundos de Ações Referenciados	48.264.213,25	5,83%	15,00%			Art. 8o, Inciso I					Alocação:	Enquadrado	
BNP PARIBAS ACE IBRX FC FIA	9.097.292,17	1,10%		42.079.629,15	21,62%	OK	OK	OK	-3,77%	4,17%	7,78%	28,70%	4,17%
GERAÇÃO FIA PROGRAMADO	8.537.924,72	1,03%		537.745.276,70	1,59%	OK	OK	OK	-2,26%	4,67%	11,27%	23,53%	4,67%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	30.628.996,36	3,70%		522.843.450,93	5,86%	OK	OK	OK	-1,86%	8,94%	10,18%	27,90%	8,94%
Fundos de Índices de Ações	5.838.353,72	0,70%	2,00%			Art. 8o, Inciso II					Alocação:	Enquadrado	
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.838.353,72	0,70%		24.560.904,45	23,77%	OK	OK	OK	-2,60%	7,65%	11,14%	29,58%	7,65%
Fundos de Ações	51.409.391,05	6,21%	15,00%			Art. 8o, Inciso III					Alocação:	Enquadrado	
ARX INCOME FI EM ACOES	17.807.777,99	2,15%		149.997.046,02	11,87%	OK	OK	OK	-2,75%	8,41%	10,52%	30,39%	8,41%
AZ QUEST ACOES FC FIA	4.967.693,03	0,60%		129.103.572,40	3,85%	OK	OK	OK	-3,94%	5,43%	7,46%	23,93%	5,43%
AZ QUEST SMALL CAPS FC FI DE ACOES	13.764.895,66	1,66%		184.150.305,46	7,47%	OK	OK	OK	-2,35%	14,00%	16,71%	34,43%	14,00%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.059.395,10	0,73%		367.770.369,37	1,65%	OK	OK	OK	-1,03%	6,28%	5,77%	14,97%	6,28%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIA	3.262.938,08	0,39%		260.156.878,49	1,25%	OK	OK	OK	-1,96%	4,48%	5,03%	13,81%	4,48%
ITAU ACOES DIVIDENDOS FI	5.546.691,19	0,67%		150.893.973,73	3,68%	OK	OK	OK	-2,85%	11,86%	27,30%	51,27%	11,86%
Fundos Multimercados	5.800.411,42	0,70%	3,00%			Art. 8o, Inciso IV					Alocação:	Enquadrado	
GERAÇÃO FUTURO FC FI MULTIMERCADO	3.012.072,38	0,36%		130.699.076,66	2,30%	OK	OK	OK	0,61%	3,47%	7,08%	13,54%	3,47%
WA US INDEX 500 FI MULTI	2.788.339,04	0,34%		176.192.815,14	1,58%	OK	OK	OK	0,91%	7,87%	15,36%	29,40%	7,87%
Fundos de Participações	7.727.860,31	0,93%	3,00%			Art. 8o, Inciso V					Alocação:	Enquadrado	
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	501.444,44	0,06%		225.990.623,26	0,22%	OK	OK	OK	-0,18%	-0,35%	-0,64%	-2,62%	-0,35%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	756.600,46	0,09%		191.066.983,50	0,40%	OK	OK	OK	-0,66%	-3,69%	-5,27%	-17,51%	-3,69%
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II	6.469.815,41	0,78%		45.935.689,28	14,08%	OK	OK	OK	0,74%	0,91%	-10,78%	-11,50%	0,91%
Fundos de Investimento Imobiliários	12.801.601,73	1,55%	3,00%			Art. 8o, Inciso VI					Alocação:	Enquadrado	
FII RB CAPITAL RENDA II	7.858.601,73	0,95%		135.826.332,85	5,79%	OK	OK	OK	0,84%	11,34%	13,17%	23,71%	11,34%
DOMO FII	4.943.000,00	0,60%		164.159.583,26	3,01%	OK	OK	OK	-4,94%	2,13%	-20,27%	-14,63%	2,13%
Disponibilidades Financeiras			0,000%										

1 - As informações utilizadas na geração deste enquadramento foram obtidas junto ao RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviços, não sendo de responsabilidade da Risk Office quaisquer erros decorrentes de ruídos ou falhas de informação;

2 - Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais a Risk Office deposita confiança. Entretanto, a Risk Office não se responsabiliza pela acurácia desses dados;

3 - Adicionalmente, é preciso ressaltar que este relatório é confidencial, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não deve, portanto, ser utilizado para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização;

4 - Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.